

Fecha de Publicación: 07 de enero de 2020

Fecha de Información: 02 de enero de 2020 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1083.9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	335.1	257.5	20.0	107.5	73.5	63.6	164.0
15-35	306.4	328.9	117.0	135.6	58.9	17.8	153.0
36-60	30.5	44.3	0.0	0.0	14.3	0.5	30.0
61-90	0.5	25.1	0.0	0.0	25.1	0.5	0.0
91-180	0.0	47.2	0.0	0.0	47.2	0.0	0.0
>180	22.7	32.8	0.0	22.0	32.8	0.7	0.0
Total	695.2	735.7	137.0	265.1	251.7	83.2	347.0

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.5 %	1.6 %	1.5 %	1.5 %
15-35	1.5 %	1.6 %	1.4 %	1.5 %
36-60	1.5 %	2.2 %	1.3 %	1.7 %
61-90	-	2.2 %	1.7 %	2.2 %
91-180	-	2.5 %	2.0 %	2.5 %
>180	-	2.7 %	2.8 %	2.7 %
Total	1.5 %	1.9 %	1.4 %	1.6 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sector	30 de dic. al 3 de enero				6 al 10 de enero				13 al 17 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	68	2783	2770	29	92	4546	3964	26	153	5330	4737
Intragruppo y off-shore***	0	0	1861	1915	0	0	2185	2775	0	0	2175	2232
Otros	68	16	238	189	92	29	471	463	153	26	1129	1666
Total	84	84	4881	4875	121	121	7202	7202	178	178	8635	8635

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.